

アセットライ

AT ADMINISTRATION (CAYMAN) LIMITED
作成日：2015年8月31日

2015年7月運用報告書(2015年7月1日～2015年7月31日)

純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：5.38%】

	設定時 (1999/2/1)	2015年3月末	2015年4月末	2015年5月末	2015年6月末	2015年7月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	1,981,356	1,962,855	1,970,226	1,866,883	1,887,543
月次騰落率	—	2.19%	-0.93%	0.38%	-5.25%	1.11%
設定来騰落率	—	98.14%	96.29%	97.02%	86.69%	88.75%

各セクターごとの損益

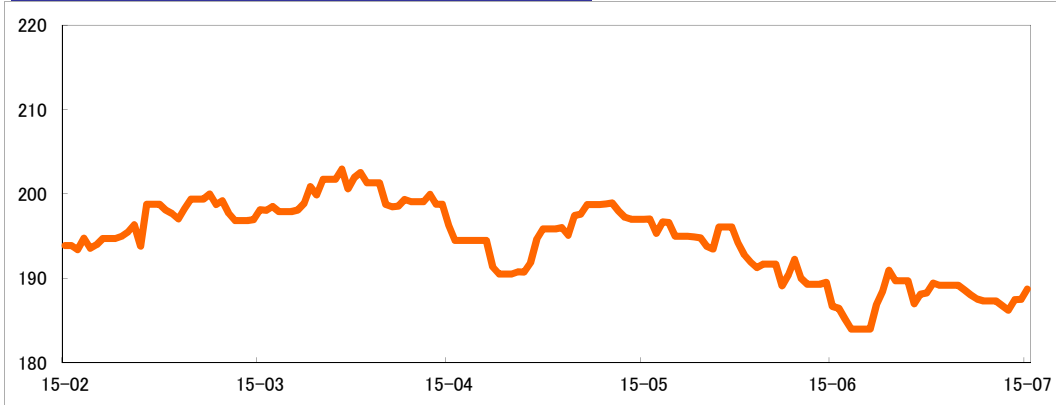
2015年7月の運用成績はプラスとなり、アセットライは前月比1.11%の利益となりました。

通貨・為替	金利	株価指数	エネルギー	金属	農産物	その他商品
-	+	-	++	+	-	+

(注) +は利益、-は損失、その数が損益の大きさを表しています。

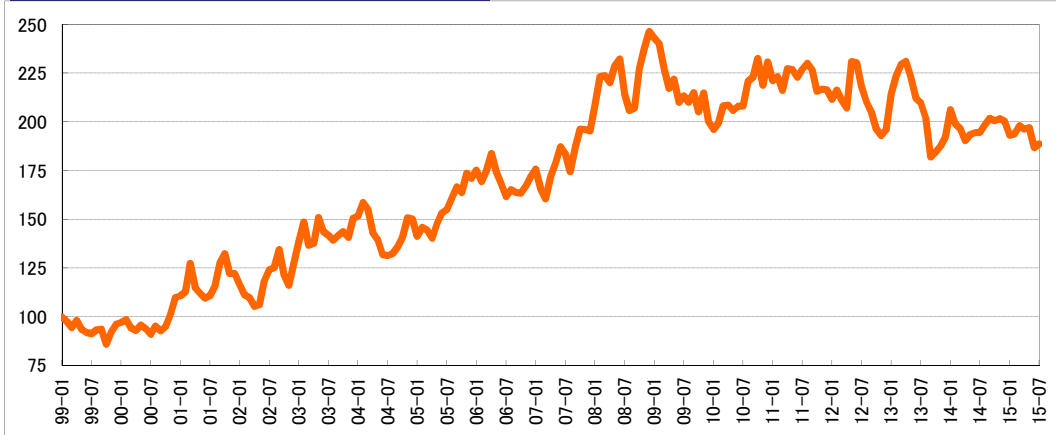
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

単位: 万円



一口あたり純資産価額の推移 設定来

単位: 万円



マーケット概要

米ドルは、対ユーロでドル高傾向となり、上旬の1ユーロ=1.12ドル台前半から、下旬の1.08ドル台までユーロ安が進展し、ドル強含みの展開となりました。また、円相場は一時120円台前半の円高水準をつけたものの、ドルの主要通貨に対する上昇傾向が定着するなかで、下旬には124円台半ばまでの円安が見られるなど、傾向的にドル高基調が強まりました。

主要国の短期金利は、円、ドル、ユーロともに金融政策を据え置くなか、概ね横ばいとなり、ユーロではマイナス金利を維持しました。長期金利は、当初ギリシャのデフォルト懸念から米英独など主要国では低下。追加支援決定後は米英の利上げ観測で上昇したものの、商品市況下落や主要国の株価伸び悩みから債券市場へ資金が流入、月末にかけて全般に利回りが低下しました。

主要国の株価指数は、当初はギリシャのデフォルト懸念や、中国株急落による同国経済への不安から全面安となりました。ギリシャの追加支援決定後は先進国市場で反発したものの、原油など商品市況の下落が資源関連企業の収益悪化につながったほか、米国の利上げ見通しも上値を抑える要因となり、伸び悩みました。一方、中国をはじめ新興国市場は全般に軟調となりました。

原油相場は、ブレントは当初の63ドルから月間を通して下落傾向となりました。中国株急落で同国経済の鈍化による需要の伸び悩みが意識される一方で、サウジアラビアの生産ペースは過去最大となるなど、供給過剰感が強まったことが圧迫。イランの核問題に対する協議が包括的合意に達し、制裁緩和による輸出増加が見込まれると一段安となり、月末には51ドル台へ下落しました。

金相場は、当初の1,175ドルを高値に下落基調となりました。1,130ドル割れで急落し、安値1,077ドルまで下落。反発後の戻りも重く軟調地合いで越月しました。9月以降の金融引締め転換が見込まれる米国の金融政策見通しを背景に、調整色の残る展開となりました。欧米ではコイン需要が増加したもののインド、中国では現物実需が減退し、金への関心が低下しました。

トウモロコシ相場は、当初は6月末の急伸から続伸しました。6月末に米農務省が発表した米国トウモロコシ作付面積が下方修正されたほか、洪水被害の影響が懸念され年初来高値を更新しました。ただ、受粉期を迎えた産地では生育に適した天候となるとともに、小麦の収穫が進むにつれて飼料穀物全般に圧迫が強まり急落、6月末の急伸前の水準へ下落しました。

《投資家の皆様へ》1999年3月以降に追加出資された方は、取得口数が参加時期により異なりますので、別添の募集月別のアセットライ評価額一覧表にてご自身の損益をご確認ください。

【お問合せ先】岡藤商事株式会社 コールセンター

フリーコール：0120-33-7639(受付時間：土日祝日を除く平日8:30～17:00)

E-mail：center@okato.co.jp Web site：http://www.shouhin-fund.com/index.html#assettry

◆当資料は金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。◆騰落率の数値は、運用開始日の1口当たりの純資産価額(¥1,000,000)を基準に算出しています。(小数点以下第3位を四捨五入)。◆当ファンドの運用成績は過去の実績に基づいたものであり、将来の運用成績を保証するものではありません。◆当ファンドの純資産価額は運用対象である商品、有価証券、通貨、金利等の先物取引や現物取引などの値動きの影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。◆当資料は当ファンドの受益者へ情報を提供することのみを目的としたものであり、ここに記載される商品の売却や購入について勧誘するものではありません。◆当ファンドは円建の積極運用追加型商品ファンドです。

■アセットトライ / 評価額一覧表(評価日: 2015年7月31日時点)

評価日	2015/7/31	※取得口数通知書内、記載の『契約コード』の上6桁をご覧ください。
純資産価額	1,887,543	※評価額(時価)⑤ = 純資産価額① × 取得口数④ ※平均年率⑧ = 運用開始来騰落率 ÷ (運用日数 ÷ 365)

※損益率の数値は、運用開始日の純資産価額(¥1,000,000)を基準に算出しています。(小数点以下第3位を四捨五入)。運用実績は過去の実績であり将来の収益を示すものではありません。また一定の利回りを金融商品取引業者および営業者が保証しているものではありません。

契約コード	運用期間 運用開始日 期間(月)	運用開始時							年率
		投資単位 ②	純資産価額 ③	取得口数 ④	評価日時点				
					評価額(時価) ⑤=①×④	評価損益 ⑥=⑤-②	損益率 ⑦=⑤÷②	⑧	
1	AT9901 1999/2/1 198ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,887,543	887,543	188.75%	5.38%	
2	AT9902 1999/3/1 197ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	1,934,306	934,306	193.43%	5.69%	
3	AT9903 1999/4/1 196ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	1,997,469	997,469	199.75%	6.10%	
4	AT9904 1999/5/6 195ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	1,921,658	921,658	192.17%	5.67%	
5	AT9905 1999/6/1 194ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	2,020,809	1,020,809	202.08%	6.31%	
6	AT9906 1999/7/1 193ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	2,053,395	1,053,395	205.34%	6.54%	
7	AT9907 1999/8/2 192ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,066,561	1,066,561	206.66%	6.66%	
8	AT9908 1999/9/1 191ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	2,023,313	1,023,313	202.33%	6.43%	
9	AT9909 1999/10/1 190ヵ月	1,000,000	937,090	1,067,133	2,014,259	1,014,259	201.43%	6.40%	
10	AT9910 1999/11/1 189ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,197,979	1,197,979	219.80%	7.60%	
11	AT9911 1999/12/1 188ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,080	2,050,022	1,050,022	205.00%	6.70%	
12	AT9912 2000/1/4 187ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	1,960,249	960,249	196.02%	6.16%	
13	AT2001 2000/2/1 186ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	1,945,409	945,409	194.54%	6.10%	
14	AT2002 2000/3/1 185ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	1,914,974	914,974	191.50%	5.93%	
15	AT2003 2000/4/3 184ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	2,000,895	1,000,895	200.09%	6.52%	
16	AT2004 2000/5/1 183ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	2,029,118	1,029,118	202.91%	6.74%	
17	AT2005 2000/6/1 182ヵ月	1,000,000	957,390	1,045,506	1,971,549	971,549	197.15%	6.40%	
18	AT2006 2000/7/1 181ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,143	2,008,615	1,008,615	200.86%	6.68%	
19	AT2007 2000/8/1 180ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,812	2,075,942	1,075,942	207.59%	7.17%	
20	AT2008 2000/9/1 179ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	1,980,236	980,236	198.02%	6.57%	
21	AT2009 2000/10/1 178ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	2,034,210	1,034,210	203.42%	6.97%	
22	AT2010 2000/11/1 177ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	1,989,585	989,585	198.95%	6.71%	
23	AT2011 2000/12/1 176ヵ月	1,000,000	1,012,677	1,087,481	1,863,912	863,912	186.39%	5.89%	
24	AT2012 2001/1/4 175ヵ月	1,000,000	1,099,531	1,090,478	1,716,678	716,678	171.67%	4.91%	
25	AT2101 2001/2/1 174ヵ月	1,000,000	1,106,736	1,090,557	1,705,502	705,502	170.55%	4.86%	
26	AT2102 2001/3/1 173ヵ月	1,000,000	1,128,441	1,086,178	1,672,699	672,699	167.27%	4.66%	
27	AT2103 2001/4/2 172ヵ月	1,000,000	1,274,671	1,078,456	1,480,807	480,807	148.08%	3.35%	
28	AT2104 2001/5/1 171ヵ月	1,000,000	1,148,518	1,070,687	1,643,459	643,459	164.35%	4.51%	
29	AT2105 2001/6/1 170ヵ月	1,000,000	1,120,460	1,089,249	1,684,613	684,613	168.46%	4.83%	
30	AT2106 2001/7/2 169ヵ月	1,000,000	1,095,410	1,091,290	1,723,138	723,138	172.31%	5.13%	
31	AT2107 2001/8/1 168ヵ月	1,000,000	1,108,831	1,091,850	1,702,280	702,280	170.23%	5.01%	
32	AT2108 2001/9/3 167ヵ月	1,000,000	1,156,883	1,086,439	1,631,575	631,575	163.16%	4.54%	
33	AT2109 2001/10/1 166ヵ月	1,000,000	1,278,225	1,072,334	1,476,689	476,689	147.67%	3.44%	
34	AT2110 2001/11/1 165ヵ月	1,000,000	1,323,490	1,055,728	1,426,185	426,185	142.62%	3.10%	
35	AT2111 2001/12/3 164ヵ月	1,000,000	1,222,200	1,081,890	1,544,368	544,368	154.44%	3.98%	
36	AT2112 2002/1/2 163ヵ月	1,000,000	1,221,883	1,081,848	1,544,780	544,780	154.48%	4.01%	
37	AT2201 2002/2/1 162ヵ月	1,000,000	1,166,737	1,085,091	1,617,796	617,796	161.78%	4.57%	
38	AT2202 2002/3/1 161ヵ月	1,000,000	1,111,645	1,089,567	1,697,971	697,971	169.80%	5.20%	
39	AT2203 2002/4/1 160ヵ月	1,000,000	1,098,307	1,094,922	1,718,592	718,592	171.86%	5.39%	
40	AT2204 2002/5/1 159ヵ月	1,000,000	1,053,547	1,094,917	1,791,606	791,606	179.16%	5.97%	
41	AT2205 2002/6/3 158ヵ月	1,000,000	1,061,310	1,094,231	1,778,501	778,501	177.85%	5.91%	
42	AT2206 2002/7/1 157ヵ月	1,000,000	1,182,603	1,085,592	1,596,091	596,091	159.61%	4.55%	
43	AT2207 2002/8/1 156ヵ月	1,000,000	1,241,166	1,080,694	1,520,782	520,782	152.08%	4.00%	
44	AT2208 2002/9/2 155ヵ月	1,000,000	1,251,288	1,079,176	1,508,479	508,479	150.85%	3.93%	
45	AT2209 2002/10/1 154ヵ月	1,000,000	1,344,590	1,074,721	1,403,805	403,805	140.38%	3.14%	
46	AT2210 2002/11/1 153ヵ月	1,000,000	1,216,142	1,082,272	1,552,073	552,073	155.21%	4.33%	
47	AT2211 2002/12/2 152ヵ月	1,000,000	1,161,070	1,086,124	1,625,691	625,691	162.57%	4.94%	
48	AT2212 2003/1/2 151ヵ月	1,000,000	1,278,691	1,078,209	1,476,151	476,151	147.62%	3.78%	
49	AT2301 2003/2/3 150ヵ月	1,000,000	1,382,741	1,072,301	1,365,072	365,072	136.51%	2.92%	
50	AT2302 2003/3/3 149ヵ月	1,000,000	1,485,812	1,067,302	1,270,376	270,376	127.04%	2.18%	
51	AT2303 2003/4/1 148ヵ月	1,000,000	1,366,283	1,073,912	1,381,515	381,515	138.15%	3.09%	
52	AT2304 2003/5/1 147ヵ月	1,000,000	1,377,293	1,072,601	1,370,471	370,471	137.05%	3.02%	
53	AT2305 2003/6/2 146ヵ月	1,000,000	1,510,066	1,062,222	1,249,972	249,972	125.00%	2.05%	
54	AT2306 2003/7/1 145ヵ月	1,000,000	1,436,823	1,069,579	1,313,690	313,690	131.37%	2.59%	
55	AT2307 2003/8/1 144ヵ月	1,000,000	1,417,256	1,070,588	1,331,827	331,827	133.18%	2.76%	
56	AT2308 2003/9/1 143ヵ月	1,000,000	1,392,804	1,071,797	1,355,210	355,210	135.22%	2.98%	
57	AT2309 2003/10/1 142ヵ月	1,000,000	1,416,896	1,075,768	1,332,167	332,167	133.22%	2.81%	
58	AT2310 2003/11/4 141ヵ月	1,000,000	1,436,951	1,069,517	1,313,573	313,573	131.36%	2.67%	
59	AT2311 2003/12/1 140ヵ月	1,000,000	1,407,221	1,071,062	1,341,325	341,325	134.13%	2.92%	
60	AT2312 2004/1/5 139ヵ月	1,000,000	1,506,668	1,063,716	1,252,792	252,792	125.28%	2.18%	
61	AT2401 2004/2/2 138ヵ月	1,000,000	1,515,744	1,065,972	1,245,291	245,291	124.53%	2.13%	
62	AT2402 2004/3/1 137ヵ月	1,000,000	1,587,195	1,063,042	1,189,231	189,231	118.92%	1.66%	
63	AT2403 2004/4/1 136ヵ月	1,000,000	1,551,768	1,064,426	1,216,381	216,381	121.64%	1.91%	
64	AT2404 2004/5/3 135ヵ月	1,000,000	1,429,064	1,069,758	1,230,823	230,823	123.08%	2.85%	
65	AT2405 2004/6/1 134ヵ月	1,000,000	1,395,055	1,068,177	1,353,022	353,022	135.30%	3.16%	
66	AT2406 2004/7/1 133ヵ月	1,000,000	1,318,409	1,075,849	1,431,680	431,680	143.17%	3.89%	
67	AT2407 2004/8/2 132ヵ月	1,000,000	1,313,299	1,076,141	1,437,252	437,252	143.73%	3.97%	
68	AT2408 2004/9/1 131ヵ月	1,000,000	1,323,594	1,075,518	1,426,072	426,072	142.61%	3.90%	
69	AT2409 2004/10/1 130ヵ月	1,000,000	1,357,884	1,073,643	1,390,060	390,060	139.01%	3.60%	
70	AT2410 2004/11/1 129ヵ月	1,000,000	1,408,023	1,071,021	1,340,561	340,561	134.06%	3.17%	

契約コード	運用期間 運用開始日 期間(月)	運用開始時							年率
		投資単位 ②	純資産価額 ③	取得口数 ④	評価日時点				
					評価額(時価) ⑤=①×④	評価損益 ⑥=⑤-②	損益率 ⑦=⑤÷②	⑧	
71	AT2411 2004/12/1 128ヵ月	1,000,000	1,507,175	1,663,492	1,252,369	252,369	125.24%	2.36%	
72	AT2412 2005/1/3 127ヵ月	1,000,000	1,500,722	1,666,645	1,257,754	257,754	125.78%	2.43%	
73	AT2501 2005/2/1 126ヵ月	1,000,000	1,412,989	1,607,719	1,335,850	335,850	133.59%	3.20%	
74	AT2502 2005/3/1 125ヵ月	1,000,000	1,459,169	1,685,521	1,293,572	293,572	129.36%	2.82%	
75	AT2503 2005/4/1 124ヵ月	1,000,000	1,445,096	1,691,995	1,306,170	306,170	130.62%	2.98%	
76	AT2504 2005/5/2 123ヵ月	1,000,000	1,402,509	1,713,007	1,345,831	345,831	134.58%	3.37%	
77	AT2505 2005/6/1 122ヵ月	1,000,000	1,478,317	1,676,444	1,276,817	276,817	127.68%	2.72%	
78	AT2506 2005/7/1 121ヵ月	1,000,000	1,532,845	1,652,381	1,231,397	231,397	123.14%	2.29%	
79	AT2507 2005/8/1 120ヵ月	1,000,000	1,551,175	1,644,672	1,216,846	216,846	121.68%	2.17%	
80	AT2508 2005/9/1 119ヵ月	1,000,000	1,607,807	1,621,965	1,173,985	173,985	117.40%	1.75%	
81	AT2509 2005/10/3 118ヵ月	1,000,000	1,666,428	1,600,085	1,132,686	132,686	113.27%	1.35%	
82	AT2510 2005/11/1 117ヵ月	1,000,000	1,637,800	1,610,575	1,152,486	152,486	115.25%	1.56%	
83	AT2511 2005/12/1 116ヵ月	1,000,000	1,735,801	1,576,102	1,087,417	87,417	108.74%	0.90%	
84	AT2512 2006/1/2 115ヵ月	1,000,000	1,710,516	1,584,618	1,103,491	103,491	110.35%	1.08%	
85	AT2601 2006/2/1 114ヵ月	1,000,000	1,752,235	1,570,699	1,077,218	77,218	107.72%	0.81%	
86	AT2602 2006/3/1 113ヵ月	1,000,000	1,693,853	1,590,370	1,114,348	114,348	111.43%	1.21%	
87	AT2603 2006/4/1 112ヵ月	1,000,000	1,747,442	1,572,265	1,080,174	80,174	108.02%	0.86%	
88	AT2604 2006/5/1 111ヵ月	1,000,000	1,837,261	1,544,288	1,027,367	27,367	102.74%	0.30%	
89	AT2605 2006/6/1 110ヵ月	1,000,000	1,744,468	1,573,240	1,082,015	82,015	108.20%	0.89%	
90	AT2606 2006/7/1 109ヵ月	1,000,000	1,680,813	1,599,490	1,122,993	122,993	112.30%	1.35%	
91	AT2607 2006/8/1 108ヵ月	1,000,000	1,616,044	1,618,095	1,168,002	168,002	116.80%	1.87%	
92	AT2608 2006/9/1 107ヵ月	1,000,000	1,652,891	1,605,000	1,141,963	141,963	114.20%	1.59%	
93	AT2609 2006/10/1 106ヵ								

「アセットトライ」に係る手数料等について

参加手数料：申込金額の2.16%（消費税含む。）

解約手数料：解約金額の1.0%（解約時にお客様が受け取る実際の受領金額は、営業指定銀行における海外送金手数料及びお客様受取銀行における事務手数料が解約償還金額から控除された金額となります。）

管理料：純資産価額の年率1.5%

先物投資顧問料：運用委託額の年率2.0%

成功報酬：運用収益の20%

先物取引手数料：（海外先物取引/海外先渡取引）原則として1枚（往復）当たり上限15米ドル
（外国為替取引）原則として百万米ドル（又は外貨の相当額）に対して上限15米ドル

業務代行報酬：純資産価額の年率0.15%

その他費用（実費）：初期費用、送金銀行に対する手数料、先物運用会社の会計監査費用、営業者及び先物運用会社の期中管理に係る費用、営業者の登録に係る費用、期中に於ける弁護士・税理士費用（ケイマン諸島に於ける弁護士費用を含む。）、関係会社及び先物運用会社のシリーズA株式に係る計算・会計事務に関わる費用、営業者株式の信託会社に対する受託費用・本商品ファンド継続販売のための書面に係る企画・改訂・印刷費用等

管理料、先物投資顧問料、成功報酬、先物取引手数料、業務代行報酬及びその他費用については、事前に計算できないため、当ファンドに係る手数料等の総額または上限額を表示することはできません。

「アセットトライ」に係るリスクと留意点

当ファンドは、先物市場等の値動きにより、大きな収益を得る可能性がある反面、投資元本を割り込む損害を受ける可能性もあるハイリスク・ハイリターンの商品です。投資する商品は多岐にわたり、各々の商品に対して買いのポジションも売りのポジションも持つため、先物市場又は外国為替市場等の特定の指標の値動きが先物運用顧問会社の判断と異なる場合は損失が発生することがあります。当ファンドは元本や収益が保証されているものではありません。資産の一部が外貨建てで運用されるため、為替の変動により収益・損失が増減することがあります。預金保険の適用はありません。当ファンドでは、1口当たりの純資産価額が700,000円を下回った場合には繰上げ償還することがあります。クーリング・オフの適用はありません。投資家が取得する商品ファンド関連受益権は、相続、遺贈、破産その他これらに準ずる場合または金融商品取引業者が転売する場合を除き、第三者には直接譲渡できません。契約締結前交付書面を十分にお読みいただき、当ファンドの特徴とリスクの内容をご理解下さい。

金融商品取引業者の概要

商号：岡藤商事株式会社

登録番号：関東財務局長（金商）第2608号

本店所在地：東京都中央区新川2-12-16

加入している金融商品取引業協会：一般社団法人第二種金融商品取引業協会